

东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证 券投资基金清算报告

基金管理人：上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告出具日期：2026 年 2 月 4 日

报告公告日期：2026 年 2 月 13 日

目录

1、重要提示	1
1. 1 重要提示	1
2、基金概况	1
2. 1 基金基本情况	1
2. 2 基金产品说明	2
3、基金运作情况说明	2
4、财务报告	3
4. 1 资产负债表(已经审计)	3
5、清算情况	4
5. 1 资产负债清算情况	4
5. 2 清算损益表	5
5. 3 截至本次清算期结束日的剩余财产分配情况	6
5. 4 基金财产清算报告的告知安排	6
6、备查文件目录	6
6. 1 备查文件目录	6
6. 2 存放地点	7
6. 3 查阅方式	7

1、重要提示

1.1 重要提示

东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会 2021 年 12 月 31 日证监许可[2021]4188 号文准予注册，《东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）于 2022 年 3 月 2 日正式生效。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《基金合同》的约定，基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2025 年 11 月 14 日至 2026 年 1 月 6 日 17:00 的期间，于 2026 年 1 月 7 日计票并表决通过《关于终止东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金合同及进行基金财产清算的议案》，本次大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日定为 2026 年 1 月 8 日，并于 2026 年 1 月 9 日进入清算程序。

基金财产清算小组由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司、基金托管人江苏银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)和上海市通力律师事务所组成。基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

2.1 基金基本情况

基金名称	东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	东方红锦融甄选 18 个月持有混合
基金主代码	014888
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置 18 个月锁定持有期（红利再投资所得份额除外）
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,256,309.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东方红锦融甄选 18 个月持有混合 A	东方红锦融甄选 18 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	014888	014889
报告期末下属分级基金的份额总额	10,963,676.55 份	292,632.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略努力实现基金资产的稳定增值。</p> <p>大类资产配置策略方面，本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中股票、债券和现金类大类资产的配置比例。</p> <p>本基金固定收益类投资策略包含普通债券投资策略，信用债投资策略，可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的投资策略，资产支持证券投资策略，债券回购杠杆策略和证券公司短期公司债券投资策略。</p> <p>本基金权益类投资策略包含行业配置策略、个股选择策略、港股投资策略和存托凭证的投资策略。</p> <p>除此之外，本基金投资策略还有股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、信用衍生品投资策略和参与融资业务策略。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×5%
风险收益特征	<p>本基金是一只混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

的特有风险。

3、基金运作情况说明

本基金由基金管理人上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基
金法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会以证监许可
[2021]4188号文批准公开募集。基金合同于2022年3月2日正式生效。本基金的基金管理
人为上海东方证券资产管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

自2022年3月2日至2026年1月8日期间，本基金按基金合同正常运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的
规定和《基金合同》的约定，上海东方证券资产管理有限公司经与江苏银行股份有限公司协
商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会并于2025年11月14日公告，
审议《关于终止东方红锦融甄选18个月持有期混合型证券投资基金合同及进行基金财产清
算的议案》。大会表决投票时间为2025年11月14日至2026年1月6日17:00的期间，于
2026年1月7日计票并表决通过《关于终止东方红锦融甄选18个月持有期混合型证券投资基金
合同及进行基金财产清算的议案》，本次大会决议自该日起生效。

基金管理人于2026年1月8日发布了《关于东方红锦融甄选18个月持有期混合型证券
投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。根据公告，本基金的最后运作
日定为2026年1月8日，并于2026年1月9日进入清算程序。进入清算程序后（即自2026
年1月9日起），基金管理人不再接受持有人提出的份额赎回和转换转出等业务申请，本基
金的申购、转换转入、定期定额投资亦不再恢复，并停止收取基金管理费、基金托管费和C
类基金份额销售服务费。

4、财务报告

4.1 资产负债表(已经审计)

单位：人民币元

资产	本期末 2026年1月8日 (基金最后运作日)
资产：	

货币资金	45, 175. 87
结算备付金	575, 504. 12
存出保证金	9, 202. 21
交易性金融资产	2, 022, 818. 63
其中：债券投资	2, 022, 818. 63
应收清算款	11, 842, 279. 01
资产合计	14, 494, 979. 84
负债：	
应付赎回款	1, 409, 750. 60
应付管理人报酬	2, 814. 97
应付托管费	527. 81
应付销售服务费	29. 36
应付交易费用	475. 00
应交税费	532. 82
其他负债	15, 000. 00
负债合计	1, 429, 130. 56
净资产：	
实收基金	11, 256, 309. 03
未分配利润	1, 809, 540. 25
净资产合计	13, 065, 849. 28
负债和净资产总计	14, 494, 979. 84

注：1、报告截止日 2026 年 1 月 8 日(基金最后运作日)，基金 A 类份额净值为 1. 1612 元，基金份额 10, 963, 676. 55 份；基金 C 类份额净值为 1. 1435 元，基金份额 292, 632. 48 份

2、本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《资产管理产品相关会计处理规定》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表无比较期间的相关数据列示。

5、清算情况

5. 1 资产负债清算情况

自 2026 年 1 月 9 日至 2026 年 1 月 12 日止为本基金清算期间，基金财产清算小组按照法律法规及本基金基金合同的规定履行基金财产清算程序，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

截至本次清算期结束日（2026 年 1 月 12 日），各项资产负债清算情况如下：

1、本基金最后运作日货币资金余额为 45, 175. 87 元（含应计利息 35. 35 元），截至清算期结束日货币资金余额为 12, 673, 142. 11 元（含应计利息 970. 12 元），应计货币资金利

息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

2、本基金最后运作日结算备付金余额为 575,504.12 元（含应计利息 126.16 元），截至清算期结束日结算备付金余额为 403,284.01 元（含应计利息 151.04 元），应计结算备付金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

3、本基金最后运作日存出保证金余额为 9,202.21 元（含应计利息 1.71 元），截至清算期结束日存出保证金余额为 9,202.57 元（含应计利息 2.07 元），应计存出保证金利息将由基金管理人以自有资金先行垫付。

4、本基金最后运作日持仓债券市值为 2,022,818.63 元，上述持仓债券已于清算期间全部卖出，截至清算期结束日已全部收到卖出款项。

5、本基金最后运作日应收清算款余额为 11,842,279.01 元，截至清算期结束日该款项已全部收到。

6、本基金最后运作日应付赎回款余额为 1,409,750.60 元，产品清算期间发生应付赎回款共计 58,032.48 元，截至 2026 年 1 月 13 日全部赎回款项已支付。

7、本基金最后运作日应付管理人报酬余额为 2,814.97 元，该款项已于 2026 年 2 月 4 日全部支付。

8、本基金最后运作日应付托管费余额为 527.81 元，该款项已于 2026 年 2 月 4 日全部支付。

9、本基金最后运作日应付销售服务费余额为 29.36 元，该款项已于 2026 年 2 月 4 日全部支付。

10、本基金最后运作日应付交易费用余额为 475.00 元，该款项已于 2026 年 1 月 16 日全部支付。

11、本基金最后运作日应交税费余额为 532.82 元，该款项已于 2026 年 2 月 4 日全部支付。

12、本基金最后运作日其他负债余额为 15,000.00 元，包括预提审计费，该款项将于取得审计费发票后支付。

5.2 清算损益表

项目	2026 年 1 月 9 日至 2026 年 1 月 12 日 (清算期间)
一、清算收益（损失）	823.58
1. 利息收入	960.01
2. 投资收益	3,263.57

3. 公允价值变动损益	- 3, 400. 00
二、清算费用	-
三、清算收益（损失）总额	823. 58
减：所得税费用	-
四、清算净收益（损失）	823. 58

注：利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2026 年 1 月 9 日至 2026 年 1 月 12 日止清算期间的活期存款利息、结算备付金利息和存出保证金利息。

5.3 截至本次清算期结束日的剩余财产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 1 月 8 日基金净资产	13, 065, 849. 28
加：清算期间净收益	823. 58
减：确认赎回对净值的影响	-58, 032. 48
二、2026 年 1 月 12 日基金净资产	13, 008, 640. 38

截至本次清算期结束日 2026 年 1 月 12 日，本基金剩余财产为人民币 13, 008, 640. 38 元。根据本基金的基金合同约定，基金财产清算小组依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日 2026 年 1 月 13 日至清算款划出前一日的收益和费用由基金份额持有人享有和承担。为保护基金份额持有人利益，加快清算速度，银行存款、结算备付金和存出保证金尚未结息的利息将由基金管理人以自有资金先行垫付，实际结息金额与垫付金额的尾差由基金管理人承担，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.4 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

6、备查文件目录

6.1 备查文件目录

- 1、东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金审计报告
- 2、关于《东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所：上海市黄浦区外马路 108 号 7 层。

6.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.dfhsm.com。

东方红锦融甄选 18 个月持有期混合型证券投资基金

基金财产清算小组

2026 年 2 月 4 日